

แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

สิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2563



บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด
Macquarie Securities (Thailand) Limited

สารบัญ

ส่วนที่ 1 ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

| | |
|--|-----|
| 1. ข้อมูลทั่วไป..... | 1 |
| 2. ปัจจัยความเสี่ยง | 3 |
| 3. ลักษณะการประกอบธุรกิจ..... | 11 |
| 4. การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ..... | 13 |
| 5. การบริหารความเสี่ยง | 14 |
| 6. ประวัติการออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์..... | 16 |
| 7. ความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ | 257 |
| 8. โครงสร้างเงินทุน | 259 |
| 9. การจัดการ | 260 |
| 10. ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงาน..... | 263 |
| 11. ข้อมูลอื่นที่เกี่ยวข้อง..... | 271 |

ส่วนที่ 2 ผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของบริษัทที่ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

| | |
|--|-----|
| 1. ผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ | 272 |
| 2. ผู้ที่เป็นคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงทั้งจำนวนของบริษัทที่ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ... | 283 |
| 3. การติดตามข้อมูลของผู้ค้ำประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง | 292 |

ส่วนที่ 3 รายละเอียดกรณีมีการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีประกันเต็มจำนวน หรือที่มีประกันบางส่วน (ถ้ามี)..... 293 |

ส่วนที่ 4 การรับรองความถูกต้องของข้อมูล 294 |

เอกสารแนบ 1

| | |
|--|-----|
| ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงและดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง..... | 295 |
|--|-----|